**<Query10>**

|  |  |
| --- | --- |
| **Subject** | **[FinBot Complete] R00363, T0 Check ABCCounterparty, TOKWV4012234, V3287890P** |
| **Sender** | RPAG\_P, Region1-MO-FX(Robot) |
| **To** | Region1-MO-FX |
| **Sent on** | 2011年5月22日 12:34 |

The details are as follows :

|  |  |
| --- | --- |
| **Robot:** | R00363\_Email\_Monitoring |
| **Process:** | Library051\_T0 Check ABCCounterparty |
| **Machine:** | TOKWV4012234 |
| **Account:** | V3287890P |
| **Time:** | 2011/05/22 (Wed) 17:35 |

確認結果は下記の通りです。ご確認してください。

05/22/2011 16:45:06 - 【NEW TRADE】通貨オプション付　約定連絡 TS ID TS3214654

TS3214654

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **【Precon-Opt】** | 権利行使タイプ | 通貨ペア | 方向 | Call / Put | 基軸通貨金額 | 権利行使レート | 決済通貨金額 |
| **FALSE** | ﾌﾟﾚｰﾝﾊﾞﾆﾗ（ﾖｰﾛﾋﾟｱﾝ） | EURUSD | 売り | EUR Call USD Put | **6,036,041.94** | 1.0859 | **6,554,537.94** |
|  | プレミアム受渡日 | プレミアム通貨 | プレミアム単価【b | プレミアム金額（対N | 権利行使日 | 権利行使期限 | 行使為替受渡日 |
|  | 2011/5/24 | EUR | 14.29249474 | 18,360.00 | 2011/6/20 | TKY15:00 | 2011/6/24 |
|  | TD | CCY pair | B/S | Call/Put | Base CCY Amt | Expiry | Delivery |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |
|  | Premium Date | Premium CCY | Premium Amt | Product = CFLW | Premium B/S | Strike | Settle Type |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **FALSE** | **FALSE** | **FALSE** | **TRUE** | **TRUE** |
|  |  |  |  |  |  |  | Cutoff |
| **【Precon-FXswap】** | 約定日時 | 基軸通貨 | 相手通貨 |  |  |  | **TRUE** |
| **TRUE** | 5/22/2011 | EUR | JPY |  |  |  |  |
|  | 売買区分（期近） | 基軸通貨金額 | 受渡日（期近） | 約定レート（期近） | 相手通貨金額（期近） |  |  |
|  | SELL | 6,054,401.94 | 5/24/2011 | 169.86 | 1,028,400,713 |  |  |
|  | 売買区分（期先） | 基軸通貨金額 | 受渡日（期先） | 約定レート（期先） | 相手通貨金額（期先） |  |  |
|  | BUY | 6,054,401.94 | 6/24/2011 | 169.2895 | 1,024,946,677 |  |  |
|  | TD | CCY1 | CCY2 |  |  |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |  |  |
| NearLeg | B/S | CCY1 Amt | VD | Rate | Product = FX |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |
| FarLeg | B/S | CCY1 Amt | VD | Rate | Product = FX |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |

**＜Answer10＞**

|  |  |
| --- | --- |
| Sybject | **RE: 【NEW TRADE】通貨オプション付　約定連絡 TS ID** TS3214654 |
| Sender | Region1-MO-Person1 |
| To | Region1-FO-Trader-Person1; Region1-FO-Trader-Person2 |
| **CC** | FX MO TKY;Region1-FO-SPGroup; Region1-FO-SPGroup-Person1; |
| Sent on | 2011年5月23日 9:05 |

Hi Region1-FO-Trader-Person1,

It seems premium is not booked. Could you check it please?

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **【Precon-Opt】** | 権利行使タイプ | 通貨ペア | 方向 | Call / Put | 基軸通貨金額 | 権利行使レート | 決済通貨金額 |  |  |  |  |
| **FALSE** | プレーンバニラ（ヨーロピアン） | EURUSD | 売り | EUR Call USD Put | **6,036,041.94** | 1.0859 | **6,554,537.94** |  |  |  |  |
|  | プレミアム受渡日 | プレミアム通貨 | プレミアム単価【bp】（対NSC） | プレミアム金額（対NSC） | 権利行使日 | 権利行使期限 | 行使為替受渡日 |  |  |  |  |
|  | 5/24/2011 | EUR | 14.29249474 | 18,360.00 | 6/20/2011 | TKY15:00 | 6/24/2011 |  |  |  |  |
|  | TD | CCY pair | B/S | Call/Put | Base CCY Amt | Expiry | Delivery |  |  |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |  |  |
|  | Premium Date | Premium CCY | Premium Amt | Product = CFLW | Premium B/S | Strike | Settle Type |  |  |  |  |
|  | **FALSE** | **FALSE** | **FALSE** | **FALSE** | **FALSE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  | Cutoff |  |  |  |  |
| **【Precon-FXswap】** | 約定日時 | 基軸通貨 | 相手通貨 |  |  |  | **TRUE** |  |  |  |  |
| **TRUE** | 5/22/2011 | EUR | JPY |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | 売買区分（期近） | 基軸通貨金額 | 受渡日（期近） | 約定レート（期近） | 相手通貨金額（期近） |  |  |  |  |  |  |
|  | SELL | 6,054,401.94 | 5/24/2011 | 169.86 | 1,028,400,713 |  |  |  |  |  |  |
|  | 売買区分（期先） | 基軸通貨金額 | 受渡日（期先） | 約定レート（期先） | 相手通貨金額（期先） |  |  |  |  |  |  |
|  | BUY | 6,054,401.94 | 6/24/2011 | 169.2895 | 1,024,946,677 |  |  |  |  |  |  |
|  | TD | CCY1 | CCY2 |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| NearLeg | B/S | CCY1 Amt | VD | Rate | Product = FX |  |  |  |  |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |  |  |  |  |
| FarLeg | B/S | CCY1 Amt | VD | Rate | Product = FX |  |  |  |  |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |  |  |  |  |

Thanks and Regards,

Region1-MO-FX